

ATA DA 61ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 04 DE DEZEMBRO DE 2019

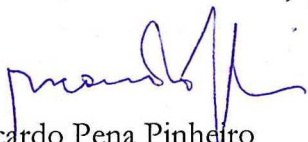
DATA, HORA E LOCAL: Às onze horas e onze minutos do quarto dia do mês de dezembro do ano de dois mil e dezenove, na sala de reuniões da sede da Funpresp-Exe. **PRESENCAS:** Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos; Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Diretor de Investimentos; Sra. Luciana Rodrigues da Cunha Gomes, Gerente de Análise, Planejamento e Pesquisa; Sr. Gilberto Tadeu Stanzione, Gerente de Operações Financeiras; e Sr. Bruno Euripedes de Moura, Gerente de Controle de Investimentos, todos membros do Comitê de Investimentos e Riscos (CIR). Registra-se, ainda, a presença do Sr. João Luiz Pinheiro Hortêncio de Medeiros, Gerente de Planejamento e Riscos, do Sr. Diego Martins Silva, Coordenador de Planejamento e Pesquisa e do Sr. Marcos de Carvalho Ordonho, Analista Previdenciário. **MESA:** Presidiu a sessão o Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, e a secretariou o Sr. Marcos de Carvalho Ordonho, Analista Previdenciário. **ORDEM DO DIA: Assuntos Deliberativos:** 1) Aprovação da Ordem do Dia; 2) PCIR 068/2019 – Parâmetros Financeiros para Concessão de Empréstimos aos Participantes Elegíveis (dezembro/2019); **Assuntos Informativos:** 3) PCIR 066/2019 – Acompanhamento de Risco de Crédito Privado (outubro/2019); 4) PCIR 060/2019 – Cálculo da Metodologia de Desinvestimentos nos Fundos Terceirizados (estratégia intra-terceirizada) (novembro/2019); e 5) Informes. **INSTALAÇÃO:** O Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê, instalou a reunião e declarou abertos os trabalhos. **DELIBERAÇÕES: Assuntos Deliberativos: Item 1)** A Ordem do dia foi aprovada pelos membros; **Item 2)** O Sr. Gilberto Tadeu Stanzione, Gerente de Operações Financeiras, apresentou, por intermédio da PCIR nº 068, e da Nota Técnica nº 519/2019/GEOF/DIRIN/Funpresp-Exe, ambas de 02 de dezembro de 2019, o resultado da aplicação da metodologia de cálculo dos parâmetros financeiros da carteira de empréstimos, aprovada pela Diretoria Executiva por intermédio da Resolução nº 764, de 13 de junho de 2017. Os membros do Comitê analisaram a matéria e determinaram que o assunto seja deliberado na próxima reunião do Colegiado; **Assuntos Informativos: Item 3)** O Sr. Bruno Euripedes de Moura, Gerente de Controle de Investimentos, apresentou, por intermédio da PCIR nº 066 e da Nota Técnica nº 515/2019/GECO/DIRIN/Funpresp-Exe, ambas de 28 de novembro de 2019, o resultado do acompanhamento do risco de crédito privado referente ao mês de outubro de 2019, tendo sido constatado que não foram identificadas mudanças no risco de crédito das

ATA DA 61ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 04 DE DEZEMBRO DE 2019

emissões ou dos emissores, bem como na probabilidade de ocorrência de desenquadramento. Adicionalmente, levando-se em consideração a manutenção da estratégia de diversificação dos investimentos pela Funpresp-Exe, não há indicação de alteração no posicionamento e de provisionamento para perdas. Os membros do Comitê tomaram conhecimento da matéria; **Item 5)** O Sr. Bruno Eurípedes de Moura, Gerente de Controle de Investimentos, apresentou por intermédio da PCIR nº 065, e da Nota Técnica nº 514/2019/GECOI/DIRIN/Funpresp-Exe ambas de 28 de novembro de 2019, o cálculo da Metodologia de Desinvestimento nos Fundos Terceirizados (estratégia intra-terceirizada). O ranking possui como objetivo determinar critérios quantitativos para determinação de dois Fundos de Investimentos Multimercado (FIMM) destinados às operações de resgates ao longo do mês de referência. Para o mês de novembro de 2019, o ranking apurado pela Gerência de Planejamento e Controle dos Investimentos foi assim determinado: 1º) Western Funp FI MM; 2º) FI Caixa Funp MM e 3º) BB Funp FI MM. Os membros do Comitê de Investimentos e Riscos tomaram ciência do assunto; e **Item 6) Informes:** **6.1)** O Sr. Bruno Eurípedes de Moura, Gerente de Controle de Investimentos, apresentou informes sobre o desempenho da Carteira de Investimentos: a carteira consolidada apresenta patrimônio líquido, até o dia 29 de novembro de 2019, de R\$ 2.226,32 milhões, com rentabilidade acumulada de 10,00% nos últimos 12 meses e de 109,19% desde o início dos Planos; e **6.2)** O Sr. Gilberto Tadeu Stanzione, Gerente de Operações Financeiras, apresentou informes sobre a estratégia de investimentos e desinvestimentos dos recursos financeiros em relação aos planos administrados: a) Planos de Benefícios ExecPrev e LegisPrev: i) As alocações entre as carteiras gerenciais de investimento, Preservação e Performance, que possuem teses de investimentos distintas, devem obedecer o direcionamento dado pelas metodologias de Alocação Objetivo e de Desvio Dinâmico; ii) As alocações em termos de segmento de aplicação, classes de ativos e prazos, devem ser realizadas em consonância com os limites estabelecidos pela Política de Investimentos para 2019, observadas as oportunidades de taxa do mercado; iii) As alocações em FIMM devem obedecer, de forma consolidada, o previsto no edital da Concorrência nº 001/2014, com base nos resultados de julho de 2018 a junho de 2019; e iv) As alocações em FIDI buscam manter saldos semelhantes em ambos os fundos. b) Plano de Gestão Administrativa (PGA): reduzir a exposição a oscilações de mercado por meio da integralização

ATA DA 61ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 04 DE DEZEMBRO DE 2019

no Fundo de Liquidez, resgates dos FIMM, e compra de ativos indexados à inflação de acordo com as necessidades de liquidez futuras. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, considerou encerrada a reunião às 12h57, à qual eu, Marcos de Carvalho Ordonho, secretário da reunião, lavrei e subscrevi esta Ata, que após lida e aprovada, segue assinada pelos presentes.



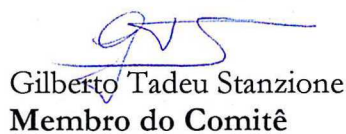
Ricardo Pena Pinheiro
Presidente do Comitê



Tiago Nunes de Freitas Dahdah
Membro do Comitê



Luciana Rodrigues da Cunha Gomes
Membra do Comitê



Gilberto Tadeu Stanzione
Membro do Comitê



Bruno Euripedes de Moura
Membro do Comitê



Marcos de Carvalho Ordonho
Secretário da Reunião